



S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten und
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade

Gültig ab dem 04.12.2017

Version: 21.51 (Update 1)

Stand: 31.05.2017

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Schlussnoten/Geschäftsbestätigungen (MT512)

Funktion: Übermittlung von Geschäftsbestätigungen und Schlussnoten im S.W.I.F.T. Format.
Folgende Geschäftsarten sind möglich:

- Maklervermittelte Geschäfte – Platz
- Bankdirektgeschäfte – Platz
- Banken-PUEV-Geschäfte
- Makler-PUEV-Geschäfte
- XONTRO Order-Geschäfte
- INVESTRO-Geschäfte
- EUFO-Geschäfte
- MAX-ONE-Geschäfte

Hinweis: Übermittlung von CCP-Geschäften zur Zeit inaktiv

Die Übertragungsparameter des Trade-Schlußnotendatenträgers können wie folgt beschrieben nach Angaben des Kunden von BrainTrade individuell parametrisiert werden:

Übertragungsparameter

- viertelstündlicher Rhythmus
- stündlicher Rhythmus
- täglicher Rhythmus
- mit DWZ-Ordernummern
- mit Bankinternen Ordernummern
- keine Ordernummern
- mit Eingabenummern
- keine Eingabenummern

Für Fragen stehen Ihnen gerne die Mitarbeiter von BRAINTRADE unter der Rufnummer 069 / 58 99 78 – 110 zur Verfügung.

Hinweis: Der Versand des Schlussnotendatenträgers erfolgt nicht über S.W.I.F.T. sondern via File Transfer. Die im Basic-Header und im Anwendungs-Header angegebene S.W.I.F.T.-Adresse wird nicht für den Versand benutzt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Beispiele für den Aufbau des Schlussnotendatensatzes:**

Der Geschäftsabwicklung vorliegende Orders:

KAUFSEITE

Bank 1: Order 1 = 100
Order 2 = 50
Bank 2: Order 3 = 250

VERKAUFSEITE

Bank 3: Order 4 = 400

Aus dem Zuteilungsalgorithmus ergeben sich die folgenden Schlussnoten (SNO) und Geschäfte (GNR):

SNO1/GNR1: Bank 1 = 150

SNO3/GNR2: Bank 2 = 250

SNO2/GNR1: Bank 3 = 150

SNO4/GNR2: Bank 3 = 250

Für jedes Geschäft werden pro Kreditinstitut ein MT 512 und ggf. 'n' MT 599 wie folgt erstellt:

SNO1 MT 512

Empfänger = Bank 1
20: GNR1
21: /MT599
23: Kauf
Anz. 150
Kontrahent Bank 3

SNO2 MT 512

Empfänger = Bank 3
20: GNR1
21: /MT599
23: Verkauf
Anz. 150
Kontrahent Bank 1

SNO1 MT 599

Empfänger = Bank 1
20: lfd. Nr.
79: GNR1 (1.Zeile/SNO-Ref.)
Order 1 (2.Zeile/ONR) Nominale 100
Order 2 (3.Zeile/ONR) Nominale 50

SNO2 MT 599

Empfänger = Bank 3
20: lfd. Nr.
79: GNR1 (1.Zeile/SNO-Ref.)
Order 4 (2.Zeile/ONR) Nominale 150

SNO3 MT 512

Empfänger = Bank 2
20: GNR2
21: Order 3
23: Kauf
Anz. 250
Kontrahent Bank 3

SNO4 MT 512

Empfänger = Bank 3
20: GNR2
21: /MT599
23: Verkauf
Anz. 250
Kontrahent Bank 2

SNO4 MT 599

Empfänger = Bank 3
20: lfd. Nr.
79: GNR2 (1.Zeile/SNO-Ref.)
Order 4 (2.Zeile/ONR) Nominale 250

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten / Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade

In der Folge ist der Aufbau des Schlussnotendatenträgers im S.W.I.F.T. Format beschrieben.

Der S.W.I.F.T. Nachrichtensatz beginnt mit dem

Basic Header

| | | | |
|-----------------------|--------------|--------------|--|
| Blockkennzeichen | = 1: | | |
| Anwendungskennzeichen | = F | (1a) | für Anwendung Finanzbereich |
| Kennung Dateneinheit | = 01 | (2n) | für System- und Benutzernachrichten |
| Adresse | = 12-stellig | (4a2a2c1c3c) | Empfänger – SWIFT – Adresse für Ausgabenachrichten |
| Sitzungsnummer | = 0000 | (4n) | Selektiertes Anwendungsprogramm |
| Folgenummer | = 999999 | (6n) | OSN (Output Sequence Number) |

Anwendungs-Header

| | | | |
|------------------------------|--|--------------------------------------|--|
| Blockkennzeichen | = 2: | | |
| Kennzeichen für Ein-/Ausgabe | = O | (1a) | für Ausgabe |
| Transaktionstyp | = 598 = 512 = 599 | (3n) (3n) (3n) | Nachrichtentyp: Vorsatz/Endesatz Nachrichtentyp: Datensatz Nachrichtentyp: Free-Form-Nachricht |
| Uhrzeit der Eingabe | = HHMM | (4n) | Erstellungsuhrzeit |
| Eingabereferenz MIR | = JJMMTT 12-stellig 0000 999999 | (6n) (4a2a2c1c3c) (4n) (6n) | Eingabedatum Sender – SWIFT - Adresse Sitzungsnummer ISN (Input Sequence Number) |
| Ausgabedatum | = JJMMTT | (6n) | |
| Uhrzeit der Ausgabe | = HHMM | (4n) | |
| Priorität | = N | (1n) | für ‚Normal‘ |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Text-Block**

Der Text einer Benutzernachricht bei S.W.I.F.T. II ist identisch mit dem Text der entsprechenden Nachricht bei S.W.I.F.T. I, mit Ausnahme eines zusätzlichen Blocktrennzeichens (= 4:).

Danach folgen die Etiketten:

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|------------|----------------|--|--|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| M | 20: | Geschäftsnummer – Börsenplatz – Börsentag (JJMMTT) – laufende Nummer | <u>3</u> n <u>6</u> n <u>7</u> n <u>3</u> n <u>6</u> n <u>7</u> n |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 14)</i> | |
| M | 21: | Order-Referenz – Konstante ' DWZ ' bei DWZ-Ordernummer – Ordernummer -> Börsentag (JJMMTT) -> laufende Nummer | 16x <u>3</u> a <u>6</u> n <u>7</u> n |
| | oder | – Konstante ' MAX ' bei MAX-ONE-Ordernummer – Ordernummer | <u>3</u> a 13n |
| | oder | – Konstante ' OTC ' bei Bankinterner OTC-Nummer – Bankinterne OTC-Nummer | <u>3</u> a 13x |
| | oder | – Konstante ' MAN ' bei manueller Eingabe (Floor-Range-Cap-Preis) – Eingabenummer | <u>3</u> a 13n |
| | oder | – Konstante ' MFM ' bei manueller Eingabe (fixer Preis) – Eingabenummer | <u>3</u> a 13n |
| | oder | – Konstante ' ZWA ' bei Zwangsschließungen in CCP-Instrumenten; zur Zeit inaktiv – Eingabenummer | <u>3</u> a 13n |
| | oder | – Bankinterne Ordernummer | [16x] |
| | oder | – ' /NONREF ' | [16x] |
| | oder | – ' MT599 ' | [16x] |

(nähere Beschreibung siehe Seite 14)

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|-----|---------|--|--------------------------------------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| M | 23: | Geschäftsart | 6a/3n/[J] /[2x]/[2x]/[1a] |
| | | – BOUGHT oder SOLD | 6a |
| | | – Satzart | /3n |
| | | – Kennzeichen-Lieferfreigabe | / |
| | | kein Inhalt | |
| | | – Kennzeichen 'IW-Geschäft' | /[J] |
| | | – Kennzeichen Eigengeschäft | /[2x] |
| | | – Kennzeichen börslich | /[2x] |
| | | 'AB' – außerbörslich | |
| | | 'BS' – börslich | |
| | | – Netting – Type | /[1a] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 16 - 18)</i> | |
| M | 31P: | Abschlussangaben | 6n3x/[2a]/[2a]/[1a]/[N] [6n,4n] |
| | | – Schlusstag (JJMMTT) | 6n |
| | | – Börsenplatz des Eingebers | 3x |
| | | – Kennzeichen für Abweichender Schlusstag 'AS' | /[2a] |
| | | – Festvaluta-Kennzeichen | /[2a] |
| | | 'FZ' – Valuta Zug um Zug | |
| | | 'FE' – Valuta Emission | |
| | | – Kennzeichen manuelle Eingabe von Zins- bzw. Diskontierungstagen 'M' | /[1a] |
| | | – Vorzeichen für Kursdifferenz (s.Feld 33S) 'N' | /[N] |
| | | – Abweichender Kontrahentenkurs | [6n,4n] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 19)</i> | |
| M | 30: | Weitere Abschlussangaben | 6n/[4n]/[3x]/[2a]/[1a] /[4x]/[3x] |
| | | – Datum-Festvaluta (JJMMTT) oder Dummywert '000000', falls keine Eingabe erfolgt ist | 6n |
| | | – Eingabe-Uhrzeit (HHMMSS) | /[6n] |
| | | – Börsenplatz des Meldewesens | /[3x] |
| | | – Kennzeichen für Abweichendes Abschlussdatum 'AA' | /[2a] |
| | | – Kennzeichen „Abwicklungsgeschäft“ | /[1a] |
| | | – MIC Venue | /[4x] |
| | | – OTC Post-Trade Indikator | /[3x] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 19 - 20)</i> | |
| M | 35A: | Art und Stückzahl/Nennwert des Wertpapiers | 3a10n,3n |
| | | – Art des Wertpapiers | 3a |
| | | – Stück oder Nennwert (Nominale) | 10n,3n |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 20)</i> | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|---|---------|---|--|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| M | 35B: | 1. Zeile - Wertpapierkennnummer 2. Zeile - Wertpapierkurzbezeichnung 3. Zeile – Verwahrart – Einheit Effektennotiz ‘1’ - Stücknotiz ‘2’ - Prozentnotiz ‘3’ - Promillenotiz – Zinssatz – Zinstermin – Kennzeichen-Wertpapier mit Poolfaktor/ Fundierungsschuldverschreibungen ‘PF’ - Wertpapiere mit Poolfaktor ‘FS’ - Fundierungsschuldverschreibungen ‘IK’ - Indexierungskoeffizient – Poolfaktor/Umrechnungsfaktor/ Indexierungskoeffizient 4. Zeile – Serien-Wertpapierkennnummer (beim Handel in Stamm-Nr. wird hier die erste in den Stammdaten gespeicherte Serie eingesetzt) | <u>ISINb12c</u> 35x <u>3n1n/[4n,9n]/[8x]</u> <u>/[2x1n,9n]</u> 3n <u>1n</u> /[4n,9n] /[8x] /[2x 1n,9n] <u>[ISINb12c]</u> |
| <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 21 - 24)</i> | | | |
| M | 82D: | Kontrahent – CBF-Konto-Nr. – LEI (Legal entity identifier) | /4n/[20x] /4n /[20x] |
| M | 87F: | Käufer/Verkäufer – Konstante ‘APMT’ = gegen Zahlung – Konstante ‘C’ für Käufer bzw. Konstante ‘D’ für Verkäufer – CBF-Konto-Nr. des Käufers/Verkäufers | 4a/1x/4n 4a /1x /4n |
| O | 87F: | Käufer/Verkäufer – Konstante ‘APMT’ = gegen Zahlung – Konstante ‘C’ für Käufer bzw. Konstante ‘D’ für Verkäufer – CBF-Konto-Nr. des Käufers/Verkäufers | 4a/1x/4n 4a /1x /4n |
| <i>(nähere Beschreibung für 82D + 87F siehe Seite 25)</i> | | | |
| M | 33T: | Abschlusskurs – Währungskennzeichen (bei stücknotierten Werten Abrechnungswährung, sonst Depotwährung) – Betrag | 3a6n,4n 3a 6n,4n |
| <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 25)</i> | | | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|-----|---------|---|--|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| O | 32M: | Kurswert – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag | <u>3a</u> 12n,2n <u>3a</u> 12n,2n |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 25)</i> | |
| O | 33S: | Kursdifferenz – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag (wenn in Feld 31P ‚N‘ steht, dann überweist der Makler, sonst erhebt der Makler) | <u>3a</u> 12n,2n <u>3a</u> 12n,2n |
| O | 34G/H | Stückzinsen – Zinstage – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Betrag (wenn bei dem Etikett 34 ‚G‘ steht, sind dies Plusstückzinsen, die zum Kurswert zu addieren sind, wenn ‚H‘ steht, sind es Minusstückzinsen, die vom Kurswert zu subtrahieren sind) | <u>3n</u> <u>3a</u> 10n,2n <u>3n</u> <u>3a</u> 10n,2n |
| O | 71C: | Gebühren und Spesen – Konstante /BROK/ – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Courtage-Betrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen wird, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird) – Vorzeichen Courtage: wenn negativ: ‚N‘, sonst frei – Courtage-Schlüssel – Courtage-Zusatzangabe ‘AC‘ – Abweichende Courtage ‘FC‘ – Franco Courtage ‘HC‘ – Halbe Courtage ‘FR‘ – Franco Rechnung ‘PC‘ – Prozentcourtage (bei maklervermittelten Geschäften) | 6* /8a/ <u>3a</u> 7n,2n/[1a] /[2x]/[2x] /8a/ <u>3a</u> 7n,2n /[1a] /[2x] /[2x] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 26 - 28)</i> | |

und/oder

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|-----|----------|---|--------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| | | – Konstante /FEES/ | /8a/ |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | 3a |
| | | – Spesen-Betrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird) | 7n,2n |
| | | – Vorzeichen Spesen Betrag: wenn negativ: 'N' , sonst frei | /[1a] |
| | und/oder | – Konstante /MISC/ | /8a/ |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | 3a |
| | | – Wiederanlage-Betrag | 7n,2n |
| | | – Vorzeichen Wiederanlagerabatt: wenn negativ: 'N' , sonst frei | /[1a] |
| | | – Kennzeichen für Wiederanlagerabatt 'WA' | /[2x] |
| | und/oder | – Konstante /MISC/ | /8a/ |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | 3a |
| | | – Bonifikations-Betrag | 7n,2n |
| | | – Vorzeichen Boni-Betrag: wenn negativ: 'N' , sonst frei | /[1a] |
| | | – Kennzeichen für Bonifikation 'BO' | /[2x] |
| | | – Boni-Schlüssel | /[2x] |
| | | '01' - % auf Kurswert | |
| | | '02' - EO pro Stück | |
| | | '03' - % auf Nennwert | |
| | und/oder | – Konstante /MISC/ | /8a/ |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | 3a |
| | | – Boni-Differenz-Betrag (negativ: Makler überweist, positiv: Makler erhebt) | 7n,2n |
| | | – Vorzeichen Boni-Diff.: wenn negativ: 'N' , sonst frei | /[1a] |
| | | – Kennzeichen für Boni-Differenz 'BD' | /[2x] |
| | und/oder | – Konstante /COMM/ | /8a/ |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | 3a |
| | | – Provisionsbetrag (negativ, wenn vom Abr.betrag abgezogen wird, positiv, wenn zum Abr.betrag addiert wird) | 7n,2n |
| | | – Vorzeichen Prov-Betrag: wenn negativ: 'N' , sonst frei | /[1a] |
| | | – Kennzeichen Provisionseingabe (falls manuelle Eingabe erfolgte) | /[2x] |
| | | 'PD' - Eingabe des Provisionsbetrags | |
| | | 'PM' - Eingabe des Promillesatz | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|-----|---------|--|---|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| O | 71B: | Abrechnungsdaten Finanzierungsschätze 1. Zeile – Letzter Tilgungstermin (letzte Fälligkeit) – Diskontsatz 2. Zeile – Diskonttage – Diskontbetrag <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 28)</i> | 8n/2n,7n3n/10n,2n 8n/2n,7n 8n /2n,7n 3n/10n,2n 3n /10n,2n |
| O | 36: | – Devisenkurs in der Form Mengennotiz auf einen Euro bezogen | 7n,11n |
| M | 34B: | Abrechnungsangaben – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) – Abrechnungsbetrag | 3a12n,2n 3a 12n,2n |
| O | 57B: | Informationen bei einem CCP-Geschäft - Kennzeichen-CCP-Geschäft ‘I’ – internes Settlement liegt vor; das Geschäft wird nicht an Clearstream weitergeleitet ‘A’ – Geschäft für die bilaterale Aggregation liegt vor; das Geschäft wird nicht an Clearstream weitergeleitet ‘B’ – Abwicklungsschlussnote aus bilateraler Aggregation ‘J’ – CCP-Geschäft liegt vor; zur Zeit inaktiv - CBF-Nummer - des Empfängers der Geschäftsbestätigung bei internem Settlement, einem Geschäft für die bilaterale Aggregation bzw. einer Abwicklungsschlussnote aus bilateraler Aggregation - des Clearing Teilnehmers bei einem CCP-Geschäft; zur Zeit inaktiv <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 28)</i> | 1a/[4n] 1a [4n] |
| O | 20F: | – TVTIC <i>(Trading Venue Transaction Identification Code)</i> | 52x |
| M | 72: | Information Sender an Empfänger 1. Zeile – Eingeber – Ursprünglicher Makler (bei Aufgabeweitergabe/-Schließung) – Ursprüngliche Geschäftsnummer (bei Aufgabeweitergabe/-Schließung, Durchlieferung, Gegengeschäft) – Ursprünglicher Schlusstag (JJMMTT) (bei Aufgabeweitergabe/-Schließung) | 4n[4n6n7n6n] 4n [4n] 6n7n 6n] |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|------|---------|--|------------------------------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| | | 2. Zeile | 4n[/6x][6n7n][N]/[N]/[2n,2n] |
| | | – Empfänger der Geschäftsbestätigung (bei Einstellung ‚incl. Filiale = J‘ erscheint hier die KV-Nr. der Filiale) | 4n |
| | | – Wertpapierkennnummer (deutsche) | [/6x] |
| | | – Wegen-Geschäftsnummer | [6n7n] |
| | | – Vorzeichen Zwischengewinn: wenn negativ: ‚N‘, sonst frei (siehe 5. Zeile) | [N] |
| | | – Vorzeichen akk. Aussch. Erträge: wenn negativ: ‚N‘, sonst frei (siehe 6. Zeile) | [/N] |
| | | – Ausgabeaufschlag | [/2n,2n] |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 29) | |
| | | 3. Zeile | <u>6n12n</u> [9n6x] |
| | | – Abschlussdatum (JJMMTT) | <u>6n</u> |
| | | – Abschlussuhrzeit (HHMMSSDDDDDD) | <u>12n</u> |
| | | – Trade-Code-Suffix | [<u>9n</u> |
| | | – Identifizierungs-Kennzeichen (Händlernummer) aus XONTRO Trade (erscheint nur bei dem Eingaber!) | <u>6x</u>] |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 30) | |
| | | 4. Zeile | [35x] |
| | | – Textfeld | |
| | | bei XONTRO Trade-Geschäften: Stelle 1-35: variabler Text bei Eingabe von 'TX' | |
| oder | | bei XONTRO Order-Geschäften: Stelle 1-5: Text ' BOSS ' ab Stelle 6: variabler Text aus Orders | |
| oder | | bei INVESTRO – Geschäften Stelle 1-9: Text ' INVESTRO ' ab Stelle 10: variabler Text aus Aufträgen | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|------|---------|--|------------------------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| oder | | bei EUFO – Geschäften Stelle 1-5: Text ' EUFO ' ab Stelle 6: variabler Text aus Aufträgen | |
| oder | | bei Max-One – Geschäften Stelle 1-4: Text ' MAX ' ab Stelle 5: variabler Text aus Max-One | |
| oder | | bei über SAKI (MT511) eingegebenen OTC- Geschäften Stelle 1-5: Text ' SAKI ' ab Stelle 6: variabler (maximal 30-stelliger) Text | |
| oder | | bei über SAKI (MT511) fremderfassten OTC- Geschäften Stelle 1-6: Text ' SAKIF ' ab Stelle 7: variabler (maximal 29-stelliger) Text | |
| oder | | bei über FIX eingegebenen OTC-Geschäfte Stelle 1-4: Text ' FIX ' ab Stelle 5: variabler (maximal 31-stelliger) Text | |
| oder | | bei über FIX fremderfassten OTC-Geschäfte Stelle 1-5: Text ' FIXF ' ab Stelle 6: variabler (maximal 30-stelliger) Text | |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 31) | |
| | | 5. Zeile | [2n,3n/[3n,7n]/7n,8n]] |
| | | – Bonisatz | [2n,3n |
| | | – Wiederanlagerabatt | [/3n,7n] |
| | | – Zwischengewinn (wenn negativ siehe 2. Zeile) | [/7n,8n]] |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 31 - 32) | |
| | | 6. Zeile | [[7n,8n]/9n,8n]] |
| | | – Ausgabepreis | [[7n,8n] |
| | | – akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag (wenn negativ siehe 2. Zeile) | [/9n,8n]] |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 32) | |
| | | 7. Zeile | [4a[11x]] |
| | | – Konstante ' PSET ' | [4a |
| | | – PSET BIC Code | [11x]] |
| | | (nähere Beschreibung siehe Seite 32) | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten / Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade

| MT | 512 | SCHLUSSNOTE/GESCHÄFTSBESTÄTIGUNG | |
|-----|---------|---|-----------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| | | 8. Zeile | [4a[11x]] |
| | | – Konstante 'DEAG' oder 'REAG' | [4a |
| | | – xEAG BIC Code | [11x]] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 9. Zeile | [35x] |
| | | – xEAG Safe Account | |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 10. Zeile | [4a[11x]] |
| | | – Konstante 'DECU' oder 'RECU' | [4a |
| | | – xECU BIC Code | [11x]] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 11. Zeile | [35x] |
| | | – xECU Safe Account | |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 12. Zeile | [4a[11x]] |
| | | – Konstante 'BUYR' oder 'SELL' | [4a |
| | | – BUYR oder SELL BIC Code | [11x]] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 13. Zeile | [35x] |
| | | – BUYR oder SELL Safe Account | |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |
| | | 14. Zeile | [3a7n,2n] |
| | | – Währungskennzeichen (Abrechnungswährung) | [3a |
| | | – Gebühren | 7n,2n] |
| | | <i>(nähere Beschreibung siehe Seite 33)</i> | |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Regeln: Etikett 20 Geschäftsnummer:

Die Geschäftsnummer wird börsentäglich fortlaufend je Börsenplatz vergeben.

Die Geschäftsnummer bei EUFO-Geschäften wird aus dem Börsenplatz (183) und der DWZ Ordernummer aufgebaut.

INVESTRO/EUFO: 183

Etikett 21 Order-Referenz :

Liegt dem Geschäft nur eine Order zugrunde, und fließt die ausgeführte Ordernominale voll in das Geschäft ein, wird je nach Parametrisierung in der Verarbeitungssteuerung in das Feld Ordernummer die DWZ-, die MAX-ONE- oder eine bankinterne Ordernummer eingestellt. Wenn die bankinterne Ordernummer als Kannfeld definiert und bei der Eingabe nicht miterfasst wurde, so wird die DWZ- bzw. die MAX-ONE-Ordernummer eingestellt.

Ist das Geschäft nicht aus einer Order entstanden, wird das Feld mit der Konstanten **'NONREF'** belegt. Genauso wird verfahren, wenn die Bank keine Order-Nummern mitgeliefert haben möchte (Parameter-gesteuert).

Wenn sich die Nominale eines Geschäftes aus mehreren Ordnern zusammensetzt bzw. wenn die ausgeführte Ordernominale nur teilweise in das Geschäft fließt und gleichzeitig eine Referenzierung von Ordnernummern gewünscht wurde, so wird das Feld mit **'MT599'** belegt. Die Daten der zugehörigen Orders befinden sich im MT599, welcher jeweils zur entsprechenden Geschäftsnummer bis zu 34 Ordnernummern inkl. der jeweiligen Nominalen enthält. Ggf. werden weitere MT599 produziert.

Dieselbe Logik wird entsprechend auch bei den manuellen Eingabe-Bezügen angewandt. Dies bedeutet unter anderem: Wenn in die Nominale des Geschäfts nur eine Teilnominale der ursprünglich vom Makler eingestellten – und mit einer „MAN...“- bzw. „MFM...“-Referenz versehenen – Position eingeht, dann steht (auch) in diesem Fall im Etikett 21 die Konstante „MT599“. Der Manuelle Eingabe-Bezug (MAN bzw. MFM) – zusammen mit der Nominalen aus dieser Eingabe, die in das betreffende Geschäft eingeflossen ist – steht dann (auch) im unmittelbar folgenden MT599, Zeile 2. Dies gilt auch dann, wenn das Geschäft nur diesen einen Eingabe-Bezug hat.

Bitte beachten Sie außerdem noch, dass in bestimmten Situationen im MT599 auch eine Mischung aus „echten“ (bankinternen oder DWZ-) Orderreferenzen und manuellen Eingabe-Bezügen enthalten sein kann.

Bei über SAKI (**MT511**) mitgegebener bankinterner OTC-Nummer wird die bankinterne OTC-Nummer mit der Konstanten **„OTC“** eingestellt.

Bei Geschäften, denen keine elektronischen Orders zu Grunde liegen, werden am Börsenplatz Frankfurt in Zukunft Eingabenummern vergeben. Diese werden mit **„MAN“** bzw. **„MFM“** bei manuellen Geschäftseingaben eingestellt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Mit „**MAN**“ gekennzeichnet Geschäftseingaben werden mit dem Floor/Range/Cap-Modell bepreist.

Bei den mit „**MF**M“ gekennzeichneten Geschäfte handelt es sich um sog. „freimaklervermittelte Depotbank-zu-Bank“-Transaktionen, die mit einem fixen Entgelt bepreist werden.

Bei Zwangsschließungen in CCP-Papieren wird hier „**ZWA**“ eingestellt. Dies ist zur Zeit inaktiv.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 23 Geschäftsart:**Feld: - Satzart**

Möglicher Wertebereich:

| | |
|-----|--------------------------------------|
| 011 | Kauf – Schlussnote |
| 012 | Kauf – Direktgeschäft |
| 013 | Kauf – Aufgabe |
| 014 | Kauf – Aufgabeschließung |
| 015 | Kauf – Aufgabeweitergabe |
| 016 | Kauf – Durchlieferung |
| 017 | Kauf – INVESTRO |
| 019 | Kauf – EUFO |
| 021 | Verkauf – Schlussnote |
| 022 | Verkauf – Direktgeschäft |
| 023 | Verkauf – Aufgabe |
| 024 | Verkauf – Aufgabeschließung |
| 025 | Verkauf – Aufgabeweitergabe |
| 026 | Verkauf – Durchlieferung |
| 027 | Verkauf – INVESTRO |
| 029 | Verkauf – EUFO |
| 417 | Kauf – Eingabebestätigung |
| 427 | Verkauf – Eingabebestätigung |
| 511 | Storno/Kauf – Schlussnote |
| 512 | Storno/Kauf – Direktgeschäft |
| 513 | Storno/Kauf – Aufgabe |
| 514 | Storno/Kauf – Aufgabeschließung |
| 515 | Storno/Kauf – Aufgabeweitergabe |
| 517 | Storno/Kauf – INVESTRO |
| 519 | Storno/Kauf – EUFO |
| 521 | Storno/Verkauf – Schlussnote |
| 522 | Storno/Verkauf – Direktgeschäft |
| 523 | Storno/Verkauf – Aufgabe |
| 524 | Storno/Verkauf – Aufgabeschließung |
| 525 | Storno/Verkauf – Aufgabeweitergabe |
| 527 | Storno/Verkauf – INVESTRO |
| 529 | Storno/Verkauf – EUFO |
| 611 | Tagesstorno/Kauf – Schlussnote |
| 612 | Tagesstorno/Kauf – Direktgeschäft |
| 613 | Tagesstorno/Kauf – Aufgabe |
| 614 | Tagesstorno/Kauf – Aufgabeschließung |
| 615 | Tagesstorno/Kauf – Aufgabeweitergabe |
| 617 | Tagesstorno/Kauf – INVESTRO |

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 23 Geschäftsart:***Feld: - Satzart***

Fortsetzung - Möglicher Wertebereich:

| | |
|-----|---|
| 621 | Tagesstorno/Verkauf – Schlussnote |
| 622 | Tagesstorno/Verkauf – Direktgeschäft |
| 623 | Tagesstorno/Verkauf – Aufgabe |
| 624 | Tagesstorno/Verkauf – Aufgabeschließung |
| 625 | Tagesstorno/Verkauf – Aufgabeweitergabe |
| 627 | Tagesstorno/Verkauf – INVESTRO |
| 817 | Storno/Kauf – Eingabebestätigung |
| 827 | Storno/Verkauf – Eingabebestätigung |
| 913 | Löschung/Kauf – Aufgabe |
| 915 | Löschung/Kauf – Aufgabenweitergabe |
| 923 | Löschung/Verkauf – Aufgabe |
| 925 | Löschung/Verkauf – Aufgabenweitergabe |

Feld: - SatzartStorno:

Der Satz entspricht dem des Ursprungsgeschäfts und hat folglich identische Vorzeichen wie das Ursprungsgeschäft.

Durchlieferung:

Diese Geschäftsart ist in Bezug auf das Ursprungsgeschäft gedreht. Es entsteht eine neue Geschäftsnummer. Das Feld Schlusstag (Feld 31P) enthält das Datum des Ursprungsgeschäfts. Die Geschäftsnummer des Ursprungsgeschäfts wird in Feld 72 (Ursprüngliche Geschäftsnummer) geliefert.

Das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ wird wie im Ursprungsgeschäft geliefert!

Tagesstorno:

Diese Nachrichten sind inhaltlich identisch mit den Storno-Nachrichten. Die Nachricht über das Ursprungsgeschäft ist im gleichen Datenträger enthalten (nicht zwingend bei mehreren Datenträgern pro Börsentag).

Aufgabenlöschung:

Es handelt sich hierbei um eine technische Löschung der Aufgabe. Die Folge ist ein Entfernen der Aufgabe aus dem Aufgabenbestand des Maklers. Es erfolgt keine Rückrechnung der angefallenen Courtage. Die Aufgabenlöschung ist nach Ablauf der Stornofrist möglich. Das Feld Schlusstag (31P) enthält den ursprünglichen Schlusstag der Aufgabe. Das Feld Geschäftsnummer (20) enthält die ursprüngliche Geschäftsnummer der Aufgabe.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 23 Geschäftsart:**Feld: - Kennzeichen 'IW-Geschäft':**

Kennzeichen, das für die Kennzeichnung im Meldesatz MT 510 herangezogen werden kann (siehe fachliche Beschreibung TRICE-Benutzerhandbuch für Filetransfer - Geschäftstyp 04).

Feld: - Kennzeichen börslich:

Hier wird die Kennzeichnung eines Geschäftes mit ‚börslich‘ (BS) oder ‚außerbörslich‘ (AB) vorgenommen.

Innerhalb der XONTRO-Handels-Schlussnote ist das Feld:

- bei XONTRO-Order- und XONTRO-Trade-Geschäften immer
- bei INVESTRO- bzw. EUFO-Geschäften g e n e r e l l mit ‚AB‘ gefüllt.

Feld: - Kennzeichen Eigengeschäft:**- innerhalb der XONTRO-Handels-Schlussnoten**

ist jeweils das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Empfängers der Geschäftsbestätigung (Etikett 72, 2.Zeile) vorhanden. Eine Ausnahme bilden Schlussnoten, bei denen es sich um Eigengeschäfte des Maklers handelt. Hier wird nicht das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Empfängers der Geschäftsbestätigung, sondern das ‚Kennzeichen Eigengeschäft‘ des Eingebers abgebildet.

Bei Bankdirektgeschäften wird dieses Kennzeichen n i c h t gefüllt.

Möglicher Wertebereich:

- EA – Eigengeschäft des Maklers aus systemseitiger Aufgabenschliessung
- EE – Eigengeschäft des Maklers
- P1 – Eigengeschäft der Bank
- A1 – Kundengeschäft der Bank

Feld: - Kennzeichen Netting - Type:

Dieses Feld ist derzeit nicht belegt.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 31P: Abschlussangaben**Feld: - Schlusstag:**

Dieses Feld enthält den Schlusstag des Geschäftes.

Feld: - Börsenplatz:

Börse, an der das Geschäft abgeschlossen wurde (Ort des Geschäftsabschlusses im Sinne des Meldewesens).

Möglicher Wertebereich:

100 – Berlin
110 – Bremen
120 – Düsseldorf
124 – Quotrix
130 – Frankfurt
140 – Hamburg
150 – Hannover
160 – München
170 – Stuttgart
183 – INVESTRO, EUFO

Feld: - Festvaluta-Kennzeichen:

Erfolgte die manuelle Eingabe der Zusatzangabe '**FZ**' oder wurde systemseitig eine Festvaluta zum Emissionsdatum '**FE**' gesetzt, so ist dieses Feld mit der entsprechenden Zusatzangabe belegt.

Bei EUFO-Geschäften wird systemseitig immer '**FZ**' gesetzt.

Etikett 30: Datum-Festvaluta enthält in diesen Fällen das zugehörige Datum.

Feld: - Kennzeichen manuelle Eingabe von Zins- bzw. Diskonttagen:

Erfolgte die manuelle Eingabe von Zinstagen über die Zusatzangabe '**ZT**' bzw. die manuelle Eingabe von Diskonttagen über die Zusatzangabe '**DT**', so wird hier das Kennzeichen '**M**' gesetzt.

Die Anzahl der Zinstage ist Etikett 34G/H: zu entnehmen.

Die Anzahl der Diskonttage ist Etikett 71B, 2.Zeile zu entnehmen.

Etikett 30: weitere Abschlussangaben**Feld: - Datum-Festvaluta:**

Bei manueller Eingabe der Zusatzangabe '**FZ**' (siehe Feld 31P - Festvaluta-Kennzeichen) oder bei systemseitiger Einstellung von '**FZ**' (im Fall von EUFO-Geschäften) oder der Festvaluta zum Emissionsdatum '**FE**' enthält dieses Feld das entsprechende Festvaluta-Datum.

Erfolgte keine Eingabe bzw. systemseitige Belegung einer Zusatzangabe ist dieses Feld mit '**000000**' belegt.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 30: weitere Abschlussangaben**Feld: - Eingabe-Uhrzeit:**

Die Uhrzeit der Eingabe des Geschäfts im Format HHMMSS.

Feld: - Börsenplatz des Meldewesens:

Bisher ist der „Börsenplatz des Eingebers“ im Feld 31P immer auch der Börsenplatz, an dem das Geschäft nach § 9 WPHG zustandegekommen ist. In Zukunft sind Konstellationen denkbar, dass Makler eines bestimmten Börsenplatzes sich an der von diesem Börsenplatz betriebenen elektronischen Börse betätigen. Dann muss diese elektronische Börse aus dem neuen Feld gemeldet werden.

Es werden die gleichen Schlüssel wie schon für den „Börsenplatz des Eingebers“ und den „Börsenplatz der Geschäftsnummer“ (Feld 20) verwendet. Neu ist der Schlüssel 124 für Quotrix.

Da das neue Feld von XONTRO Trade immer versorgt wird, kann es in Zukunft generell für die Meldung nach § 9 WPHG benutzt werden.

Feld: - Kennzeichen „Abweichendes Abschlussdatum“:

Das Kennzeichen wird immer dann gesetzt, wenn das Abschlussdatum in Feld 72, 3. Zeile vom Schlusstag in Feld 31P abweicht. Der Schlüssel ist „AA“.

Feld: - Kennzeichen „Abwicklungsgeschäft“:

Das Kennzeichen ist als reines Vorratsfeld für zukünftige Anforderungen des Meldewesens vorgesehen.

Dieses Feld ist zur Zeit inaktiv.

Feld: - MIC Venue:

Segment MIC, falls verfügbar, sonst operational MIC

Feld: - OTC Post-Trade Indikator:

OTC post-trade Indikator

001 = ACTX (Compensation)

002 = CANC (Storno)

101 = ACTX + CANC

Etikett 35A: - Art und Stückzahl/Nennwert des Wertpapiers

Das Unterfeld 'Art des Wertpapiers' ist generell mit einem der folgenden Codewörter belegt:

| | | |
|-----|---|----------------------------|
| SHS | = | Aktien |
| BON | = | Renten |
| BCE | = | zertifikatsähnliche Renten |
| WTS | = | Warrants |
| CER | = | Zertifikate |
| FUN | = | Fonds |
| SUB | = | Nebenrechte |
| RTE | = | Genussrechte |
| UNT | = | Units |
| MSC | = | Sonstige |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Etikett 35B: Wertpapierangaben****1. Zeile – Wertpapierkennnummer (ISIN)**

Existiert in den Wertpapier-Stammdaten keine ISIN-WKN, wird programmseitig 'XX0000000000' als Dummywert eingestellt.

3. Zeile**Feld: - Verwahrart**

Ein Wert der Verwahrart entspricht dem Feld Verwahrmöglichkeit der WM-Tabelle G16. Beispiele des möglichen Wertebereichs (unvollständig):

- 000 Keine Feldeingabe
- 001 GS, Jungscheinkonto bis zum Erscheinen der Stücke
- 002 GS, Jungscheinkonto, stückelos nach Einlieferung der Globalurkunde(n)
- 003 GS, eine Globalurkunde für die gesamte Laufzeit
- 005 GS, interimistische Globalurkunde bis zum Erscheinen der Stücke
- 006 GS, Schuldbuchgirokonto Einz. Schuldb. Ford.mögl.
- 007 GS, Schuldbuchgirokonto Einz. Schuldb. Ford. nicht möglich
- 008 GS, Miteigent. Anteil an Inhaber-Sammelzertifikat der CBF
- 009 Girosammelverwahrung
- 010 GS, NGS
- 011 GS, stückelos effekt. Stcke nur bei ausl. Lagerstelle ein- und auslieferbar
- 012 GS, techn. Globalurk. (nicht GS-faeh. Einzelurk.koennen im Umlauf sein).
- 013 GS, Zentralverwahre Direktverwahrung
- 014 GS, Rahmenurkunde (BIS-ZU) fuer die gesamte Laufzeit
- 015 GS, interimistische Rahmenurkunde (BIS-ZU) bis zum Erscheinen d. Stck
- 016 GS, technische Globalurkunde (BIS-ZU)
- 019 GS, Miteigentum
- 020 Streifbandverwahrung
- 021 Streifbandverwahrung per Erscheinen
- 022 Streifbandverwahrung sog. Haussammelverwahrung
- 023 Streifbandverwahrung Schuldbucheintragung, keine GS-Verwahrung
- 024 STR, nur depotmäßige Einbuchung (keine effekt. Stcke, keine Globalurk.)
- 040 Wertpapierrechnung (Stücke effektiv lieferbar)
- 041 Titel in die Auslandsabwicklung CBF aufgenommen (Stcke effekt. lieferb.)
- 042 Auslandsabwicklung der CBF, Cedel hat Globalurkunde ausgetauscht (Stücke effekt. lieferbar)
- 043 Auslandsabwicklung der CBF, Cedel in interimist. Globalurkunden
- 044 Titel in Auslandsabwicklung der CBF (nicht effektiv lieferbar)
- 045 Auslandsabw. der CBF, Cedel in perm. Globalurkunden (Stcke n. Eff. lief.)
- 046 Auslandsabwicklung der CBF, in interimistischen Globalurkunden
- 047 Auslandsabwicklung der CBF, in permanenten Globalurkunden
- 048 Auslandsabwicklung der CBF, Globalurkunden wurden ausgetauscht
- 049 Wertpapierrechnung (Stücke nicht effektiv lieferbar)
- 050 NEW Look Global Note (NGN)
- 088 Streifband, Sonstige (Indices, Derivate, etc.)
- 091 Streifband, Haussammelverwahrung bei Interims-WKN
- 092 Streifband bei Interims-WKN
- 093 Wertpapierrechnung bei Interims-WKN
- 096 GS, CBF-Eing., GS-IGL bei Interims-WKN
- 097 GS, CBF-Eing GS bei Interims-WKN
- 098 GS, CBF-Eing GS-SVG bei Interims-WKN
- 099 AKV-Interne WKN Ausland bei Interims-WKN

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Etikett 35B: Wertpapierangaben****3. Zeile****Feld: - Zinstermin**

Beispiele des möglichen Wertebereichs (unvollständig):

| | |
|----------|--|
| tt.01.G | tt. Januar ganzjährig |
| tt.02.G | tt. Februar ganzjährig |
| tt.03.G | tt. März ganzjährig |
| tt.04.G | tt. April ganzjährig |
| tt.05.G | tt. Mai ganzjährig |
| tt.06.G | tt. Juni ganzjährig |
| tt.07.G | tt. Juli ganzjährig |
| tt.08.G | tt. August ganzjährig |
| tt.09.G | tt. September ganzjährig |
| tt.10.G | tt. Oktober ganzjährig |
| tt.11.G | tt. November ganzjährig |
| tt.12.G | tt. Dezember ganzjährig |
| tt.J/J | tt. Januar/Juli halbjährig |
| tt.F/A | tt. Februar/August halbjährig |
| tt.M/S | tt. März/September halbjährig |
| tt.A/O | tt. April/Oktober halbjährig |
| tt.M/N | tt. Mai/November halbjährig |
| tt.J/D | tt. Juni/Dezember halbjährig |
| 31M01O | 31. März/01. Oktober halbjährig |
| tt.01.4M | tt. Januar/Mai/September viermonatlich |
| tt.02.4M | tt. Februar/Juni/Oktober viermonatlich |
| tt.03.4M | tt. März/Juli/November viermonatlich |
| tt.04.4M | tt. April/August/Dezember viermonatlich |
| tt.01.VJ | tt. Januar/April/Juli/Oktober vierteljährlich |
| tt.02.VJ | tt. Februar/Mai/August/November vierteljährlich |
| tt.03.VJ | tt. März/Juni/September/Dezember vierteljährlich |
| tt.01.2M | tt. ab Januar zweimonatlich |
| tt.02.2M | tt. ab Februar zweimonatlich |
| tt.01.1M | tt. monatlich |
| tt.01.9M | tt. Januar/Oktober neunmonatlich |
| tt.02.9M | tt. Februar/November neunmonatlich |
| tt.03.9M | tt. März/Dezember neunmonatlich |
| tt.04.9M | tt. April/Januar neunmonatlich |
| tt.05.9M | tt. Mai/Februar neunmonatlich |
| tt.06.9M | tt. Juni/März neunmonatlich |
| tt.07.9M | tt. Juli/April neunmonatlich |
| tt.08.9M | tt. August/Mai neunmonatlich |
| tt.09.9M | tt. September/Juni neunmonatlich |
| tt.10.9M | tt. Oktober/Juli neunmonatlich |
| tt.11.9M | tt. November/August neunmonatlich |
| tt.12.9M | tt. Dezember/September neunmonatlich |
| tt.01.5M | tt. Januar/Juni/November fünfmonatlich |
| tt.02.5M | tt. Februar/Juli/Dezember fünfmonatlich |
| tt.03.5M | tt. März/August/Januar fünfmonatlich |
| tt.04.5M | tt. April/September/Februar fünfmonatlich |
| tt.05.5M | tt. Mai/Oktober/März fünfmonatlich |
| tt.06.5M | tt. Juni/November/April fünfmonatlich |
| tt.07.5M | tt. Juli/Dezember/Mai fünfmonatlich |
| tt.08.5M | tt. August/Januar/Juni fünfmonatlich |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| | |
|----------|--|
| tt.09.5M | tt. September/Februar/Juli fünfmonatlich |
| tt.10.5M | tt. Oktober/März/August fünfmonatlich |
| tt.11.5M | tt. November/April/September fünfmonatlich |
| tt.12.5M | tt. Dezember/Mai/Oktober fünfmonatlich |
| tt.01.7M | tt. Januar/August siebenmonatlich |
| tt.02.7M | tt. Februar/September siebenmonatlich |
| tt.03.7M | tt. März/Oktober siebenmonatlich |
| tt.04.7M | tt. April/November siebenmonatlich |
| tt.05.7M | tt. Mai/Dezember siebenmonatlich |
| tt.06.7M | tt. Juni/Januar siebenmonatlich |
| tt.07.7M | tt. Juli/Februar siebenmonatlich |
| tt.08.7M | tt. August/März siebenmonatlich |
| tt.09.7M | tt. September/April siebenmonatlich |
| tt.10.7M | tt. Oktober/Mai siebenmonatlich |
| tt.11.7M | tt. November/Juni siebenmonatlich |
| tt.12.7M | tt. Dezember/Juli siebenmonatlich |
| tt.01.8M | tt. Januar/September achtmonatlich |
| tt.02.8M | tt. Februar/Oktober achtmonatlich |
| tt.03.8M | tt. März/November achtmonatlich |
| tt.04.8M | tt. April/Dezember achtmonatlich |
| tt.05.8M | tt. Mai/Januar achtmonatlich |
| tt.06.8M | tt. Juni/Februar achtmonatlich |
| tt.07.8M | tt. Juli/März achtmonatlich |
| tt.08.8M | tt. August/April achtmonatlich |
| tt.09.8M | tt. September/Mai achtmonatlich |
| tt.10.8M | tt. Oktober/Juni achtmonatlich |
| tt.11.8M | tt. November/Juli achtmonatlich |
| tt.12.8M | tt. Dezember/August achtmonatlich |
| tt.01.ZM | tt. Januar/November zehnmonatlich |
| tt.02.ZM | tt. Februar/Dezember zehnmonatlich |
| tt.03.ZM | tt. März/Januar zehnmonatlich |
| tt.04.ZM | tt. April/Februar zehnmonatlich |
| tt.05.ZM | tt. Mai/März zehnmonatlich |
| tt.06.ZM | tt. Juni/April zehnmonatlich |
| tt.07.ZM | tt. Juli/Mai zehnmonatlich |
| tt.08.ZM | tt. August/Juni zehnmonatlich |
| tt.09.ZM | tt. September/Juli zehnmonatlich |
| tt.10.ZM | tt. Oktober/August zehnmonatlich |
| tt.11.ZM | tt. November/September zehnmonatlich |
| tt.12.ZM | tt. Dezember/Oktober zehnmonatlich |
| tt.01.EM | tt. Januar/Dezember elfmonatlich |
| tt.02.EM | tt. Februar/Januar elfmonatlich |
| tt.03.EM | tt. März/Februar elfmonatlich |
| tt.04.EM | tt. April/März elfmonatlich |
| tt.05.EM | tt. Mai/April elfmonatlich |
| tt.06.EM | tt. Juni/Mai elfmonatlich |
| tt.07.EM | tt. Juli/Juni elfmonatlich |
| tt.08.EM | tt. August/Juli elfmonatlich |
| tt.09.EM | tt. September/August elfmonatlich |
| tt.10.EM | tt. Oktober/September elfmonatlich |
| tt.11.EM | tt. November/Oktober elfmonatlich |
| tt.12.EM | tt. Dezember/November elfmonatlich |
| tt.01.ZJ | tt. Januar zweijährig |
| tt.02.ZJ | tt. Februar zweijährig |
| tt.03.ZJ | tt. März zweijährig |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

| | |
|----------|---|
| tt.04.ZJ | tt. April zweijährig |
| tt.05.ZJ | tt. Mai zweijährig |
| tt.06.ZJ | tt. Juni zweijährig |
| tt.07.ZJ | tt. Juli zweijährig |
| tt.08.ZJ | tt. August zweijährig |
| tt.09.ZJ | tt. September zweijährig |
| tt.10.ZJ | tt. Oktober zweijährig |
| tt.11.ZJ | tt. November zweijährig |
| tt.12.ZJ | tt. Dezember zweijährig |
| FLAT/ZE | kein Zinstermin; Zahlung am Ende der Laufzeit |
| FLAT/KZ | kein Zinstermin |
| ABZINS | Abzinsung (nur ADCA-Sparbrief) |

3. Zeile**Feld: - Poolfaktor/Umrechnungsfaktor/Indexierungskoeffizient**

Bei Wertpapieren mit Poolfaktor (u.a. ABS-Papiere) wird die Tilgung am Stück durch einen Poolfaktor ausgedrückt. Der Kurswert errechnet sich wie folgt:

Kurswert = Nominale x Kurs x Poolfaktor

Bei Young-Fundierungsschuldverschreibungen muss bei der Ermittlung des Kurswertes ein Umrechnungsfaktor beachtet werden. Der Kurswert errechnet sich wie folgt:

Kurswert = Nominale x Kurs x Umrechnungsfaktor / Devisenkurs
(falls vorhanden)

Bei Wertpapieren mit Indexierungskoeffizient (in der Nennwertvariante) muss bei der Ermittlung der Geschäftsnominale der Indexierungskoeffizient (vom Geldvaluta-Datum) berücksichtigt werden. Die Geschäftsnominale errechnet sich wie folgt:

Geschäftsnominale = Nominale x Indexierungskoeffizient

4. Zeile**Feld: - Serien-Wertpapierkennnummer**

Wenn der Verkäufer in einer Serien-Wertpapierkennnummer handelt, wird die Serien-WKN (im ISIN-Format) in der ersten Zeile des Etiketts 35B geliefert und die 4. Zeile dieses Feldes bleibt leer. Die zugehörige Stamm-WKN (im WKN-Format) wird in Etikett 72/2. Zeile geliefert.

Wenn der Verkäufer/Käufer in einer Stamm-WKN handelt, wird die Stamm-WKN (im ISIN-Format) in der ersten Zeile des Etiketts 35B geliefert und die 1. Serien-WKN (im ISIN-Format) in Zeile 4 eingestellt. In Feld 72/2. Zeile wird ebenfalls noch einmal die Stamm-WKN (im WKN-Format) geliefert.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten / Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade

Etikett 82D: Kontrahent

Das Feld ist immer mit der CBF-Nummer **und des LEI** des **Abwicklungsinstituts** der Gegenseite belegt, auch wenn dieses gleichzeitig Handelsteilnehmer der Gegenseite ist.

Bei EUFO-Geschäften enthält das Feld 82D die Teilnehmer-Nummer des Vestima-Kontrahenten.

Die folgende Belegung ist zur Zeit inaktiv:

Bei Parkett-Geschäften mit CCP ist der CCP im Feld 82D Kontrahent und im Feld 87F der Gegenseite zu finden.

Etikett 87F: Käufer/Verkäufer

Das Feld wird in jeder Schlussnote zweimal geliefert und enthält die CBF-Nummer des **Handelsteilnehmers** der eigenen und der Gegenseite, auch wenn der Handelsteilnehmer gleichzeitig Abwicklungsinstitut ist.

Die Spezifizierung erfolgt über die Konstanten:

,C' für Käufer

,D' für Verkäufer

Bei EUFO-Geschäften enthalten die Felder 87F die Teilnehmer-Nummer des Vestima-Kontrahenten und die des Investro Teilnehmers.

Die folgende Belegung ist zur Zeit inaktiv:

Bei Parkett-Geschäften mit CCP ist der CCP im Feld 82D Kontrahent und im Feld 87F der Gegenseite zu finden.

Etikett 33T: Abschlusskurs

Enthält bei EUFO-Geschäften den Rücknahmepreis (NAV).

Etikett 32M: Kurswert

Enthält bei EUFO-Geschäften den Kurswert gebildet aus NAV x Nominale.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Etikett 71C: Gebühren und Spesen*****Feld: - Courtage-Betrag***

Bei maklervermittelten Geschäften fließt die Courtage nicht in den Abrechnungsbetrag mit ein.

Bei Bankdirektgeschäften wird bei negativem Courtagebetrag vom Abrechnungsbetrag subtrahiert, bei positivem Vorzeichen wird die Courtage zum Abrechnungsbetrag addiert.

Staffel 1 für Renten:

Wird seit dem 01.09.1999 nicht mehr verwendet!

Staffel 2 für Renten:

Für Anleihen von Bund, Bahn, Post, Länder, KfW und Dt. Ausgleichsbank, Staatsbank Berlin, Treuhandanstalt, ERP, Fonds "Deutsche Einheit", Deutsche Reichsbahn und Ausgleichsfonds Währungsumstellung, Fundierungsschuldverschreibungen.

Bei nicht auf Euro lautenden Emissionen wird die Nominale in Euro umgerechnet.

| | | | | |
|---|---------------|------------------------|----------|---------------------------|
| 0 | = bis | 25.000 | 0,7500 ‰ | vom Nennwert; min. 0,75 |
| 1 | = über bis | 25.000 50.000 | 0,4000 ‰ | vom Nennwert; min. 18,75 |
| 2 | = über bis | 50.000 125.000 | 0,2800 ‰ | vom Nennwert; min. 20,00 |
| 3 | = über bis | 125.000 250.000 | 0,2600 ‰ | vom Nennwert; min. 35,00 |
| 4 | = über bis | 250.000 500.000 | 0,1600 ‰ | vom Nennwert; min. 65,00 |
| A | = über bis | 500.000 1.000.000 | 0,1000 ‰ | vom Nennwert; min. 80,00 |
| B | = über bis | 1.000.000 1.500.000 | 0,0750 ‰ | vom Nennwert; min. 100,00 |
| C | = über bis | 1.500.000 2.000.000 | 0,0625 ‰ | vom Nennwert; min. 112,50 |
| D | = über bis | 2.000.000 2.500.000 | 0,0600 ‰ | vom Nennwert; min. 125,00 |
| E | = über bis | 2.500.000 3.500.000 | 0,0500 ‰ | vom Nennwert; min. 150,00 |
| F | = über bis | 3.500.000 5.000.000 | 0,0400 ‰ | vom Nennwert; min. 175,00 |

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Etikett 71C: Gebühren und Spesen**

| | | | | | |
|---|--------|------------|----------|--|-----------------------------|
| G | = über | 5.000.000 | | | |
| | bis | 15.000.000 | 0,0300 ‰ | | vom Nennwert; min. 200,00 |
| H | = über | 15.000.000 | | | |
| | bis | 25.000.000 | 0,0250 ‰ | | vom Nennwert; min. 450,00 |
| I | = über | 25.000.000 | | | |
| | bis | 50.000.000 | 0,0200 ‰ | | vom Nennwert; min. 625,00 |
| J | = über | 50.000.000 | 0,0150 ‰ | | vom Nennwert; min. 1.000,00 |

Staffel 3 für Renten:

Für Optionsanleihen cum und Wandelanleihen; für auf Reichsmark lautende Emissionen; für %-notierte Genussscheine; für Zerobonds und Asset Backed Securities (ABS) auf Basis des Kurswertes.

Für die übrigen Emissionen, die nicht in der Rentenstaffel 2 berücksichtigt werden; für Indezertifikate auf Basis des Kurswertes. Bei nicht auf Euro lautenden Emissionen wird die Nominale in Euro umgerechnet.

| | | | | | |
|---|--------|-----------|----------|--|---------------------------|
| 0 | = bis | 25.000 | 0,7500 ‰ | | vom Nennwert; min. 0,75 |
| 1 | = über | 25.000 | | | |
| | bis | 50.000 | 0,4000 ‰ | | vom Nennwert; min. 18,75 |
| 2 | = über | 50.000 | | | |
| | bis | 125.000 | 0,2800 ‰ | | vom Nennwert; min. 20,00 |
| 3 | = über | 125.000 | | | |
| | bis | 250.000 | 0,2600 ‰ | | vom Nennwert; min. 35,00 |
| 4 | = über | 250.000 | | | |
| | bis | 500.000 | 0,1600 ‰ | | vom Nennwert; min.65,00 |
| 5 | = über | 500.000 | | | |
| | bis | 1.000.000 | 0,1200 ‰ | | vom Nennwert; min. 80,00 |
| 6 | = über | 1.000.000 | | | |
| | bis | 2.500.000 | 0,0800 ‰ | | vom Nennwert; min. 120,00 |
| 7 | = über | 2.500.000 | 0,0600 ‰ | | vom Nennwert: min. 200,00 |

Staffel für Aktien,Bezugsrechte und Optionsscheine sowie stücknotierte Genussscheine:

Für die Aktienwerte des DAX-30 wird an allen Börsenplätzen

0,4 ‰ des Kurswertes, mind. 0,75 EUR

und für alle übrigen Werte

0,8 ‰ des Kurswertes, mind. 0,75 EUR (Börsenplatz Berlin: 0,4 ‰ ab 01.04.01)

berechnet.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 71C: Gebühren und Spesen**Feld: - Courtage-Schlüssel**

Die Ziffern in der ersten Spalte stellen den Courtage-Schlüssel aus den jeweiligen Courtage Staffeln dar.

Hierbei ist zu beachten, daß Schlussnoten, die aus der Zuteilung heraus erstellt werden, keinen Courtage-Schlüssel erhalten, da in diesem Fall evtl. Die Ursprungsnominale verändert wurde.

Feld: - Courtage-Zusatzangabe

Die Courtage-Zusatzangabe ‚PC‘, die nur bei maklervermittelten Geschäften erfaßt werden kann, wird z.Zt. innerhalb des Datenträgers in ‚AC‘ umgesetzt.

Etikett 71B: Abrechnungsdaten Finanzierungsschätze**2. Zeile****Feld: - Diskonttage / Diskontbetrag**

Diskonttage und Diskontbetrag werden generell ohne Vorzeichen geliefert. In dem Falle, dass das Feld Diskontsatz oder Diskonttage mit Null belegt ist, werden trotzdem alle Felder gefüllt.

Etikett 57B: Informationen bei einem CCP-Geschäft**Feld: Kennzeichen 'CCP-Geschäft' bzw. 'Internes Settlement':**

Geschäfte des internen Settlements werden mit der Konstanten ‚I‘ gekennzeichnet; die mit ‚I‘ gekennzeichneten Geschäfte werden nicht zur Belieferung an Clearstream weitergeleitet und müssen vom Empfänger selbst verbucht werden.

Geschäfte für die bilaterale Aggregation, die mit ‚A‘ gekennzeichnet sind, werden nicht zur Belieferung an Clearstream weitergeleitet.

Abwicklungsschlussnoten aus der bilateralen Aggregation werden mit ‚B‘ gekennzeichnet und zur Belieferung an die Clearstream weitergeleitet.

Die folgende Belegung ist zur Zeit inaktiv:

Alle Parkett-Geschäfte mit Kontrahent CCP, die zu einem so genannten CCP-Geschäft geführt haben, werden als solche gekennzeichnet. Diese Geschäfte sind im Brutto Liefermanagement (BLM) des CCP enthalten.

Feld: CBF-Nummer (Clearing Teilnehmer bzw. Empfänger):

Bei internem Settlement, bei einem Geschäft für die bilaterale Aggregation sowie bei Abwicklungsschlussnoten aus der bilateralen Aggregation wird hier die CBF-Nummer des Empfängers der Geschäftsbestätigung (identisch mit dem Etikett 72, 2. Zeile) eingetragen.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten / Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade

Die folgende Belegung ist zur Zeit inaktiv:

Hier wird der Clearer des Handelsteilnehmers (= NCM gemäß CCP-Kriterien) bei einem CCP-Geschäft (Parkett) mit seiner CBF-Nummer mitgeteilt. In den Fällen, wo ein Eintrag in den Kundenstammdaten nicht vorhanden ist, wird dieses Feld nicht belegt.

Etikett 20F: TVTIC (Trading venue transaction identification code)

Etikett 72: Information Sender an Empfänger

1. Zeile

Feld: - Eingeber

- bei Parkett-Geschäften enthält dieses Feld die 4-stellige KV-Nummer der eingebenden Bank bzw. des eingebenden Maklers
- bei INVESTRO- bzw. EUFO-Geschäften enthält dieses Feld die 4-stellige KV-Nummer des Auftragsempfängers (OHA)

Feld: - Ursprünglicher Makler/ - Geschäftsnummer/ - Schlusstag

Die Kombination der Felder 'Ursprünglicher Makler', 'Ursprüngliche Geschäftsnummer' und 'Ursprünglicher Schlusstag' ist nur bei Aufgabenschließungen und Aufgabenweitergaben möglich.

Bei Durchlieferungen wird das Feld 'Ursprüngliche Geschäftsnummer' versorgt.

Bei der Schließung von taggleichen Aufgaben und den daraus resultierenden Schlussnoten kann ein 'Ursprünglicher Schlusstag' dokumentiert werden.

2. Zeile

Feld: - Empfänger der Geschäftsbestätigung

Dieses Feld enthält die 4-stellige KV-Nummer der empfangenden Bank der Geschäftsbestätigung. Es handelt sich um das Institut (Filiale oder Zentrale), das am Geschäftsabschluss beteiligt war. Im Header der Nachricht steht generell die SWIFT-Adresse der Zentrale bei allen Nachrichten.

Wurde im Rahmen der Verarbeitungssteuerung die Auswahl 'Incl. Filialen' getroffen, steht hier die Filialnummer, deren Daten die Zentrale erhält.

Feld: - Ausgabeaufschlag

Das Feld ist als reines Vorratsfeld vorgesehen. Über die Befüllung wird im Rahmen des nächsten INVESTRO-Releases entschieden.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 72: Information Sender an Empfänger**3. Zeile****Feld: - (Abweichendes) Abschlussdatum / - Abschlussuhrzeit**

Dieses Feld dient der Meldepflicht gemäß §9 WpHG und ist derzeit immer identisch mit dem (ggf. Abweichenden) Schlusstag (Etikett 31P).

Ab 29.10.2001 kann dieses Feld mit einem ‚Abweichenden Abschlussdatum‘ belegt sein, welches **kein** Börsentag ist. Hiermit sollen die Geschäfte abgebildet werden, die von den Teilnehmern außerhalb der Börsentage abgeschlossen werden. In diesen Fällen ist das Abschlussdatum nicht mehr identisch mit dem (ggf. Abweichenden) Schlusstag (Etikett 31P)!

Feld: - Trade-Code-Suffix

Dieses Feld ist zur Zeit mit neun Nullen belegt.

Feld: - Identifizierungs-KennzeichenXONTRO Trade Direktgeschäfte

Hier werden die letzten 6 Stellen des Identifizierungs-Kennzeichens des Eingebers dokumentiert.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 72: Information Sender an Empfänger**4. Zeile****Feld: - Textfeld**

In diesem Feld wird der Text aus XONTRO Trade, XONTRO Order, MAX-ONE, INVESTRO bzw. EUFO angezeigt.

Die folgenden Felder werden nur von INVESTRO-Teilnehmern benötigt!

5. Zeile**Feld: - Bonisatz**

Es handelt sich hierbei entweder um den Bonisatz aus der Konditionstabelle INVESTRO:

- es wird der Bonisatz 1 eingestellt, wenn der Kauf nicht zur Wiederanlage erfolgte,
 - es wird der Bonisatz 2 eingestellt, wenn der Kauf zur Wiederanlage erfolgte
- oder*
um den in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegebenen Bonisatz.

Bei EUFO-Geschäften ist das Feld immer 0.

Feld: - Wiederanlagerabatt

Das Feld wird gefüllt, sofern ein Wiederanlagerabatt in WSS hinterlegt ist
oder
falls der Wiederanlagerabatt in der Geschäftseingabe INVESTRO (Kürzel „WR“) eingegeben wurde.

Bei EUFO-Geschäften ist das Feld nicht belegt.

**S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /
Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 72: Information Sender an Empfänger***Feld: - Zwischengewinn***

Das Feld wird gefüllt, sofern ein Zwischengewinn in WSS hinterlegt ist
oder
falls der Zwischengewinn in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde.

Bei einem negativen Zwischengewinn wird das entsprechende negative Vorzeichen in Etikett 72, 2. Zeile abgebildet.

Bei EUFO-Geschäften ist das Feld nicht belegt.

6. Zeile***Feld: - Ausgabepreis***

Das Feld wird gefüllt bei Kaufaufträgen, die zur Wiederanlage oder zur Rücknahme preisausgezeichnet wurden
oder
falls der Ausgabepreis in der Geschäftseingabe INVESTRO (Kürzel „AP“) eingegeben wurde.

Bei EUFO-Geschäften ist das Feld immer 0.

Feld: - akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag

Das Feld wird gefüllt, sofern ein akkumulierter ausschüttungsgleicher Ertrag in WSS hinterlegt ist
oder
falls der akkumulierte ausschüttungsgleiche Ertrag in der Geschäftseingabe INVESTRO eingegeben wurde.

Bei einem negativen akkumulierten ausschüttungsgleichen Ertrag wird das entsprechende negative Vorzeichen in Etikett 72, 2. Zeile abgebildet.

Bei EUFO-Geschäften ist das Feld nicht belegt.

**Hinweis: in den Zeilen 7 - 13 wird bei EUFO-Geschäften die Settlement Chain des Kontrahenten (Vestima-Teilnehmer) angezeigt.
Die Zeilen 7 - 14 sind bei EUFO-Geschäften immer belegt.**

7. Zeile***Feld: - PSET***

Angabe des Place of Settlement als BIC.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade**

Etikett 72: Information Sender an Empfänger**8. Zeile****Feld: - DEAG oder REAG**

Angabe des Delivering oder Receiving Agents. Wenn nicht vorhanden, steht hier nur „DEAG“ oder „REAG“.

9. Zeile**Feld: - xEAG Safe Account**

Angabe des Safe Accounts des Delivering oder Receiving Agents am Place of Settlement. Wenn nicht vorhanden, wird hier „MSC-NONREF“ geliefert.

10. Zeile**Feld: - DECU oder RECU**

Angabe des Custodians. Wenn nicht vorhanden, steht hier nur „DECU“ oder „RECU“.

11. Zeile**Feld: - xECU Safe Account**

Angabe des Safe Accounts des Custodians beim Delivering oder Receiving Agent. Wenn nicht vorhanden, wird hier „MSC-NONREF“ geliefert.

12. Zeile**Feld: - BUYR oder SELL**

Käufer oder Verkäufer als BIC. Wenn nicht vorhanden, steht hier nur „BUYR“ oder „SELL“.

13. Zeile**Feld: - BUYR oder SELL Safe Account**

Safe Account des Käufers oder Verkäufers. Wenn nicht vorhanden, wird hier „MSC-NONREF“ geliefert

14. Zeile**Feld: - Gebühren**

Die Zeile enthält das Währungskennzeichen und die Gebühren (Differenz aus ausmachendem Betrag und Kurswert). Wenn keine Gebühr berechnet wurde, ist das Feld mit 0 belegt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Free-Form-Nachricht (MT 599)**

(Zuordnung von Orders zu Schlussnoten)

Funktion: Dieser Nachrichtentyp wird zur Übermittlung der von einer Schlussnote betroffenen Orders und deren Nominalen verwendet, sofern eine Referenzierung gemäß Parametrisierung in der Verarbeitungssteuerung gewählt wurde.

Dieser Nachrichtentyp wird nur in Verbindung mit einem MT512 angewendet.
(Weitere Hinweise siehe MT512, Feld 21)

| MT | 599 | FREE-FORM-NACHRICHT | |
|-----|---------|---|----------------------------|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| M | 20: | Auftragsnummer (TRN, lfd.Nr.) | 6n7n |
| M | 79: | 1. Zeile: - Geschäftsnummer, der die nachfolgenden Angaben (2.- 26. Zeile) zuzuordnen sind (Etikett 20 aus MT512) - Satzart (entspricht dem Unterfeld „Satzart“ aus dem Etikett 23 des MT512) | 3n6n7n/3n 3n6n7n /3n |
| | | 2.- 26. Zeile: Unterfeld 01: DWZ-Order-Nr. aus MT596 mit Voranstellung 'DWZ' als Konstante | DWZ6n7n |
| | | oder MAX-ONE-Order-Nr. mit Voranstellung 'MAX' als Konstante | MAX6n7n |
| | | oder Eingabenummer aus manueller Geschäftseingabe mit Voranstellung 'MAN' als Konstante (Floor-Range-Cap-Preis) | MAN6n7n |
| | | oder Eingabenummer aus manueller Geschäftseingabe mit Voranstellung 'MFM' als Konstante (fixer Preis) | MFM6n7n |
| | | oder bankinterne Order-Nr. aus MT 500/501 | 16x |
| | | zur Zeit inaktiv: Eingabenummer aus Zwangsschließung in CCP-Papieren mit Voranstellung 'ZWA' als Konstante | ZWA6n7n |
| | | Unterfeld 02: Art des Wertpapiers (analog Feld 35A) Stück oder Nennwert (Nominale) | /3a 10n, 3n |
| | | Anteiliger Abrechnungsbetrag | 10n, 4n |

Regeln Wurde das Kennzeichen 'Bankinterne Ordernummer' in der Verarbeitungssteuerung ausgewählt und sind keine bankinternen Ordernummern vorhanden, wird im Unterfeld 01 die DWZ- bzw. die MAX-ONE-Ordernummer eingestellt.

S.W.I.F.T.-Nachrichtenformate für Schlussnoten /**Geschäftsbestätigungen aus XONTRO Trade****Vorsatz und Endesatz für Schlussnoten-Datenträger aus XONTRO Trade (MT598)**

Funktion: Dieser Nachrichtentyp wird für den Vor- und Endesatz des Schlussnoten-Datenträgers aus XONTRO Trade verwendet.

| MT | 598 | VORSATZ/ENDESATZ FÜR SCHLUSSNOTEN-DATENTRÄGER | |
|-----|---------|---|---|
| O/M | ETIKETT | FELDBEZEICHNUNG | FORMAT |
| M | 20: | Auftragsnummer (TRN) - JJMMTT (Börsentag) - Lfd. Nr. | <u>6</u> n <u>7</u> n <u>6</u> n <u>7</u> n |
| M | 12: | Nachrichtentyp, der in dieser Nachricht übermittelt wird 000 - Vorsatz 002 - Endesatz | <u>3</u> n |
| M | 77E: | Nachricht gem. besonderer Vereinbarung (siehe Regeln) | 73x |

Regeln:**Feld 20 (lfd. Nr.):**

Dieses Feld enthält die DWZ-interne Übertragungsnummer pro Bank. Sie wird für alle von XONTRO Trade übermittelten Übertragungen pro Bank und Börsentag fortlaufend hochgezählt. Die DWZ-internen Übertragungsnummern in Vor- und Nachsatz sind pro übertragenem Stapel identisch.

Feld 77E:**Vorsatz einer Übertragung (Feld 12: 000)**

Übertragungskennung 10x6n6n6n[/1a]
10x
'BOEGA-SDT' (Parkett-Datenträger)
oder
'BOEGA-SDTA' (Parkett-DT aus der Abendbörse)

Erstellungsdatum (JJMMTT) 6n
Erstellungsuhrzeit (HHMMSS) 6n
Börsentag (JJMMTT) 6n
Kennzeichen - letzte Übertragung des BOEGA-SDT vom Börsentag 'L' - letzte Übertragung [/1a]

Endesatz einer Übertragung (Feld 12: 002)

10x6n/10n,3n/12n,2n
Übertragungskennung 'BOEGA-SDT' 10x
Anzahl übertragener Sätze (inkl. Vor- und Endesatz) 6n
Nominalbetrag (Feld 35A; Addition aus allen MT512; Überlauf wird vernachlässigt) /10n,3n
Abrechnungsbetrag (Feld 34B; Addition aus allen MT512; Überlauf wird vernachlässigt) /12n,2n